Identifying Interbank Loans, Rates, and Claims Networks from Transactional Data

Borradores de Economia
Número:
881
Publicado:
Miércoles, 1 Abril 2015
Clasificación JEL:
E42, E44
Palabras clave:
Furfine's Method, Interbank, IBR, TIB
Descargar documento

Lo más reciente

La Fecundidad en Colombia: Evolución Reciente y Factores Socioeconómicos Asociados
Juliana Jaramillo-Echeverri, Adriana Sofía Rodríguez
Movilidad espacial, oportunidad económica, y crimen
Gaurav Khanna, Carlos Alberto Medina-Durango, Anant Nyshadham, Daniel Ramos-Menchelli, Jorge Andrés Tamayo-Castaño, Audrey Tiew
Pronosticando inflaciones de canastas de alimentos desagregadas en Colombia usando un modelo XGBoost
Cesar Anzola-Bravo, Poveda-Olarte Paola
Otras Publicaciones

We identify interbank (i.e. non-collateralized) loans from the Colombian large-value payment system by implementing Furfine's method. After identifying interbank loans from transactional data we obtain the interbank rates and claims without relying on fin